

<<Copula理论及其在金融分析上的应用>>

图书基本信息

书名：<<Copula理论及其在金融分析上的应用>>

13位ISBN编号：9787302179122

10位ISBN编号：7302179123

出版时间：2008-8

出版时间：清华大学出版社

作者：韦艳华，张世英 著

页数：164

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

## 内容概要

《Copula理论及其在金融分析上的应用》对Copula理论和方法进行了系统的介绍，特别是针对中国金融市场的应用做了大量的实证工作，有利于加深读者对Copula理论、方法及其应用的理解。

全书共分五章，第一章介绍Copula函数的定义、基本性质和相关理论，讨论基于Copula理论的一致性和相关性测度，探讨常用的几Copula函数的基本性质及其在金融分析中的应用。

第2章详细讨论Copula理论在多变量时间序列模型（包括Copula-GARCH类模型和Copula-SV类模型）的构建、估计和检验等问题，研究中国股市的相关模式和相关结构。

第3章和第4章讨论时变相关Copula模型和变结构Copula模型的建模方法和应用特点，研究中国股市动态相关性和变结构特点。

第5章讨论Copula理论的仿真技术及其投资组合风险分析问题，包括多元正态Copula、t-Copula和多元阿基米德Copula函数的仿真技术以及相应的投资组合风实证分析，Copula模型在金融波动溢出分析和信用风险分析中的应用。

## 作者简介

韦艳华，女，1974年生，广西柳州人，2001 - 2004年就读于天津大学管理学院，师从张世英教授，获管理学博士学位。  
2004 - 2007年在中国人民大学一大公国际资信评估有限公司博士后工作站从事信用与行业风险方面的研究工作。  
目前是中国社会科学院 - 中国银行博士后工作站博士后。  
主要研究方向：金融计量、信用评级、行业研究和风险管理等。  
主要成果：主持、完成多项金融机构委托的研究项目，一项中国博士后基金资助项目，参与两项自然科学基金项目，在国内核心学术期刊、金融报刊发表论文或专题研究报告十余篇。

张世英，男，1936年生，北京市人。  
1960年毕业于北京大学教学力学系。  
1960 - 1970年在国防部第五研究院和酒泉基地从事研究工作。  
1978年到天津大学后长期从事系统工程理论、方法及其应用的研究和教学工作，担任多家学术刊物编委。  
主要研究方向：系统识别，社会经济系统分析，社会经济系统建模、规划与控制等。  
主要成果：主持、完成八项国家自然科学基金项目。  
先后获国家科技进步奖二等奖一项（1987），原国家教委科技进步奖三等奖一项（1993），原煤炭部管理科学优秀成果一等奖一项（1997），天津市科技进步三等奖两项（1994，2002）。  
已出版学术著作和教材10部，在国内外重要学术刊物发表大量论文，其中仅在数量经济方面发表论文计206余篇。  
培养博士80余名，硕士约250名。

## 书籍目录

第1章 Copula理论与相关性分析1.1 Copula函数的定义与基本性质1.1.1 二元Copula函数1.1.2 多元Copula函数1.1.3 条件Copula函数1.2 基于Copula函数的相关性测试1.2.1 基于Copula函数的相关性测度的特点1.2.2 基于Copula函数的相关性测试1.2.3 基于Copula函数的尾部相关测度1.3 常用的Copula函数与相关性分析1.3.1 Copula函数的分类1.3.2 常用的二元Copula函数与相关性分析1.4 Copula模型的建构方法、1.5 Copula模型的估计和检验1.5.1 Copula模型的参数估计方法1.5.2 非参数核估计方法1.5.3 Copula模型的检验和评价1.6 本章小结参考文献第2章 基于Copula理论的多变量金融时间序列模型2.1 金融时间序列的边缘分布模型2.1.1 时间序列的一般模型2.1.2 ARCH类模型2.1.3 随机波动模型2.2 基于Copula理论的多变量金融时间序列模型2.2.1 多元Copula-ARMA模型2.2.2 多元Copula-ARMA类模型2.2.3 多元Copula-SV类模型2.3 基于M-Copula-GARCH模型的中国股票市场相关程度与相关模型实证研究2.3.1 Copula模型的选择、2.3.2 Copula模型的估计结果与评价2.3.3 中国股票市场相关程度与相关模式分析2.4 本章小结参考文献第3章 时变相关Copula模型3.1 时变相关参数演化方程的探讨3.2 时变相关的二元正态Copula模型3.3 时变相关的二元Joe-ClaytonCopula模型3.3.1 条件尾部相关系数3.3.2 时变相关的二元Joe-ClaytonCopula模型3.4 上海股票市场各行业板块动态相关性的实证研究3.4.1 Copula模型的选择3.4.2 Copula模型的估计结果与评价3.4.3 上海股票市场各行业板块之间相关关系及Copula模型刻画能力分析3.5 本章小结参考文献第4章 变结构Copula模型4.1 Copula模型变结构问题描述4.2 变结构边缘分布模型4.2.1 分析段建模的波动模型4.2.2 变截距波动模型4.2.3 具有Markov结构转换机制的变结构波动模型4.3 变结构点的诊断与Copula变结构模型4.3.1 分阶段构建Copula模型4.3.2 二元正态Copula模型变结构点的诊断4.3.3 具有尾部变结构特性的二元Copula模型4.3.4 具有变结构边缘分布的变结构Copula模型4.4 中国股票市场变结构问题的实证研究.....第5章 Copula理论在金融风险管理上的应用符号说明

章节摘录

第1章 Copula理论与相关性分析 Copula理论的提出要追溯到1959年, Sklar指出, 可以将一个联合分布分解为k个边缘分布和一个Copula函数, 这个Copula函数描述了变量间的相关性。由此看出, Copula函数实际上是一类将联合分布函数与它们各自的边缘分布函数连接在一起的函数, 因此也有人将它称为连接函数。

本章在介绍Copula函数定义和基本性质的基础上, 探讨基于Copula函数的相关性测度, 重点讨论几类常用Copula函数的性质及其在相关性分析上的应用特点, 最后介绍Copula模型的构建方法和几种常用的参数估计和检验方法。

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>